



Backtest #50449 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v422

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.00%	-0.36	33.3%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v422 sobre el contrato de oro GC=F muestra una ineficiencia operativa crítica, con una rentabilidad negativa del 4.00% y una tasa de ganancia del 33.3% en solo tres operaciones. El ratio de Sharpe de -0.36 y un máximo de caída del 12.60% indican que la gestión de riesgo es inadecuada para este activo, probablemente debido a una exposición excesiva en una muestra estadísticamente insignificante. Dado que los resultados provienen de un número insuficiente de transacciones, no existe suficiente confianza estadística para validar el modelo ni extrapolar su desempeño a futuros mercados. El siguiente paso inmediato es ejecutar una prueba de estrés con más de 100 operaciones simuladas para distinguir

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.00%
Sortino Ratio	-0.18
Turnover	5.75x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9603.04